



ICAPUÍ

 Outubro a Dezembro de 2021



Patrimônio
R\$ 12.507.425,11

Rentabilidade
Mês Acum.
0,83% 1,13%

Meta
Mês Acum.
1,17% 4,33%

Gap
Mês Acum.
-0,34% -3,20%

VaR
0,34%

Evolução do Patrimônio

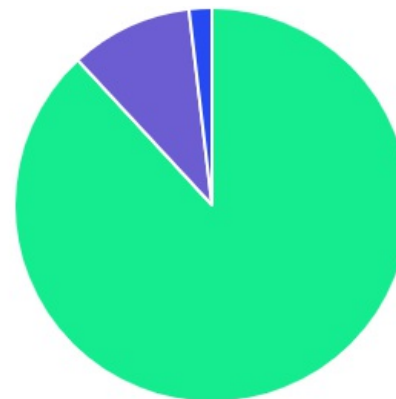


Comparativo (Rentabilidades | Metas)

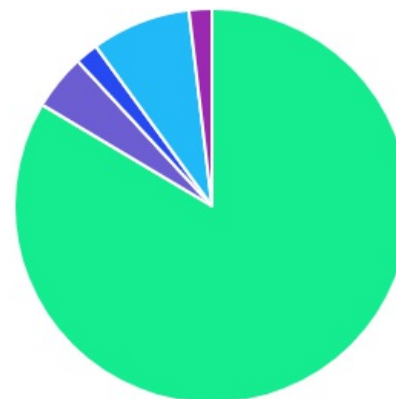


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 1.721.416,14	13.76%	D+1	-	R\$ 13.021,67	0,76%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 1.585.646,06	12.68%	D+1	-	R\$ 11.119,34	0,71%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.268.138,20	10.14%	D+3	-	R\$ 2.438,43	0,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	R\$ 0,00	0.00%	D+0	-	R\$ 4.583,88	0,21%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	R\$ 598.496,08	4.79%	D+2	-	R\$ -3.691,49	-0,61%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 230.221,77	1.84%	D+0	-	R\$ 1.927,71	0,84%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 2.535.317,17	20.27%	D+1	-	R\$ 22.965,41	0,91%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 2.514.285,74	20.10%	D+0	-	R\$ 20.590,08	0,83%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 25.090,48	0.20%	D+0	-	R\$ 1.039,19	0,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 543.911,96	4.35%	D+3	-	R\$ 5.890,69	0,76%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 235.174,01	1.88%	D+3	-	R\$ 11.060,77	4,94%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	R\$ 510.928,05	4.08%	D+5	-	R\$ 6.749,02	1,34%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 505.977,92	4.05%	D+3	-	R\$ 6.359,89	1,27%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 232.821,53	1.86%	D+3	-	R\$ 3.897,86	1,70%
Total investimentos	R\$ 12.507.425,11	100.00%			R\$ 107.952,45	0,83%
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 12.507.425,11	100.00%			-	-

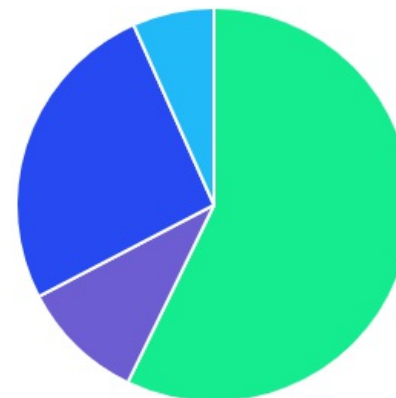
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	88,13%	R\$ 11.022.523,60	
Renda Variável	10,01%	R\$ 1.252.079,98	
Investimentos no Exterior	1,86%	R\$ 232.821,53	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



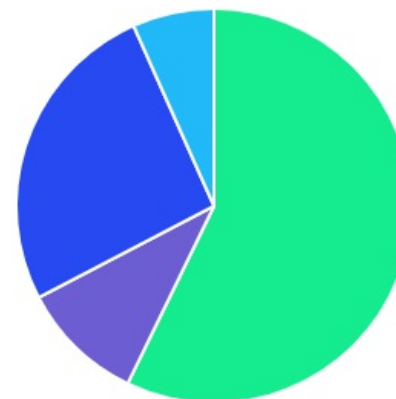
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	83,58%	R\$ 10.453.521,16	
Artigo 8º, Inciso III	8,13%	R\$ 1.016.905,97	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	4,55%	R\$ 569.002,44	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1,88%	R\$ 235.174,01	
Artigo 9º - A, Inciso III	1,86%	R\$ 232.821,53	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



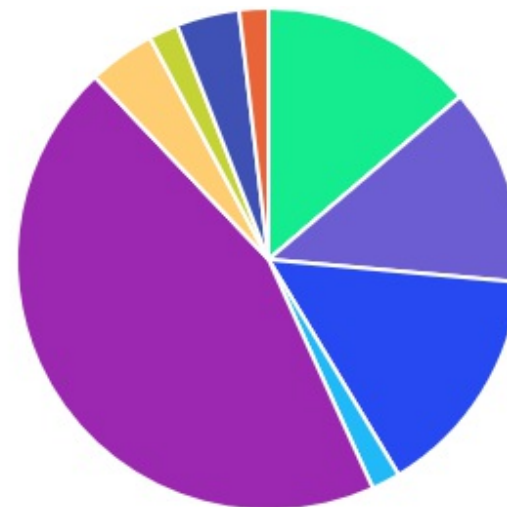
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,19%	R\$ 7.152.531,63	
CAIXA DISTRIBUIDORA	26,01%	R\$ 3.253.085,19	
BANCO DO NORDESTE	10,14%	R\$ 1.268.138,20	
SUL AMÉRICA	6,67%	R\$ 833.670,09	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,19%	R\$ 7.152.531,63	
CAIXA ECONOMICA	26,01%	R\$ 3.253.085,19	
SANTANDER CACEIS	10,14%	R\$ 1.268.138,20	
BEM - DISTRIBUIDORA	6,67%	R\$ 833.670,09	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	44,72%	R\$ 5.593.514,87	
IMA-B	14,92%	R\$ 1.866.634,28	
IMA-B 5	13,76%	R\$ 1.721.416,14	
IDKA IPCA 2A	12,68%	R\$ 1.585.646,06	
CDI	4,29%	R\$ 536.018,53	
125% do CDI	4,05%	R\$ 505.977,92	
IBOVESPA	1,88%	R\$ 235.174,01	
GLOBAL BDRX	1,86%	R\$ 232.821,53	
IRF-M 1	1,84%	R\$ 230.221,77	
Total	100,00%	R\$ 12.507.425,11	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN	100%	R\$ 10.453.521,16	83.58%	40,00%	60,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
Operações Compromissadas	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa Referenciados	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Renda Fixa	40%	R\$ 569.002,44	4.55%	0,00%	10,00%	40,00%
FI de Índices Renda Fixa	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	40,00%
Letras Imobiliárias Garantidas	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB)	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
Poupança	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI Debêntures	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 11.022.523,60	88,13%			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações Referenciados	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Índices Ações Referenciados	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI em Ações Livre	20%	R\$ 235.174,01	1.88%	0,00%	7,00%	20,00%
FI de Índices em Ações Livre	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	20,00%
FI Multimercado	10%	R\$ 1.016.905,97	8.13%	0,00%	1,00%	10,00%
FI em Participações	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Imobiliário	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 1.252.079,98	10,01%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Renda Fixa - Dívida Externa	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Investimento no Exterior	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Ações – BDR Nível I	10%	R\$ 232.821,53	1.86%	0,00%	3,00%	10,00%
Total Investimentos no exterior		R\$ 232.821,53	1,86%			
Total Global		R\$ 12.507.425,11	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2021			IPCA + 5.42% a.a.			
Outubro	R\$ 0,00	R\$ 13.072.036,33	1,69%	R\$ 13.900.996,14	-1,39%	-3,08%
Novembro	R\$ 13.072.036,33	R\$ 13.845.731,26	1,39%	R\$ 223.750,26	1,71%	0,32%
Dezembro	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	1,17%	R\$ 107.952,45	0,83%	-0,34%
Total	R\$ 13.845.731,26	R\$ 12.507.425,11	4,33%	R\$ 14.232.698,85	1,13%	-3,20%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Out (%)	Nov (%)	Dez (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	-0,52%	0,77%	0,84%	1,10%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,18%	0,02%	0,21%	0,41%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	-1,25%	2,43%	0,71%	1,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-1,63%	1,73%	0,91%	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	-0,66%	0,91%	0,83%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-2,56%	3,44%	0,21%	1,00%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	-1,27%	2,47%	0,76%	1,94%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	10,93%	-0,89%	1,70%	11,81%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-2,35%	3,21%	0,19%	0,98%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RF LP	09.326.708/0001-01	-3,41%	3,13%	-0,61%	-1,00%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.458.144/0001-02	-11,57%	-5,67%	4,94%	-12,47%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	-1,47%	0,12%	1,27%	-0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	-0,90%	1,54%	0,76%	1,40%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	35.292.597/0001-70	-0,07%	0,63%	1,34%	1,91%